



DIRETORIA DE INVESTIMENTOS

Relatório Mensal de Investimentos

SETEMBRO

Rio de Janeiro
2012

Diretoria de Investimentos

Antonio Paulo Vogel de Medeiros – Diretor

Gerência de Operações e Planejamento

Marcio Martins Rocha Ramos – Gerente
Flávia Affonso Teixeira – Coordenadora de Planejamento
Angela Maria Monteiro Pandolfo
Carlos Augusto Bastos Fernandes
Ubirajara da Silva Coelho
Luciana Pinto Venâncio
Fabio Rodrigo Amaral de Assunção

Fundo Único de Previdência do Estado do Rio de Janeiro – RIOPREVIDÊNCIA
Rua da Quitanda nº 106
20.011-030 – Centro – Rio de Janeiro – RJ
Telefone: (21) 2332-5757
Home page: www.rioprevidencia.rj.gov.br

Elaborado por : Carlos Augusto B. Fernandes – Assessor de Risco - DIN - mat. 180.313-9

RELATÓRIO MENSAL DE INVESTIMENTOS

Setembro de 2012

CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA DO RIOPREVIDÊNCIA		(R\$)
A - Disponível		1.341.565.209
B - Segmento de Renda Fixa		111.205.586
1 - Carteiras Próprias		111.205.586
2- Operação Compromissada - Lastro: TPF		0
C - Segmento de Imóveis		196.344.485
1 - Carteiras Próprias		196.344.485
D - Fundos de Investimento		1.034.015.138
1 - Fundos de Curto Prazo		0
2 - Fundos Referenciados DI		810.850.144
3 - Fundos de Renda Fixa RF IMA		223.164.994
4 - Fundos Multimercado		0
5 - Fundos de Ações		0

A composição das aplicações do RIOPREVIDÊNCIA no encerramento do mês de setembro se apresentou conforme as tabelas abaixo, dentro dos limites estabelecidos na Resolução nº 3.922/10 do CMN, e do Plano Anual de Investimentos.

Rioprevidência - Setembro de 2012

Posição consolidada da carteira por tipo de risco	(R\$)	(% do total)
1- Títulos Públicos Federais	774.330.293	57,7%
1.1 - Prefixados (LTN, NTN-F)	217.053.462	16,2%
1.2 - Pós-fixados (LFT - Selic, LTN com DI-1 Selic, Op.Comp.)	446.071.245	33,3%
1.3 - IPCA (NTN-B)	0	0,0%
1.4 - IGP-DI (CFT - Carteira Própria)	111.205.586	8,3%
2- Títulos Privados de Renda Fixa	370.888.581	27,6%
2.1 - Emissores de baixo risco de crédito (I)	334.534.928	24,9%
2.2 - Cotas de Fundos (II)	36.353.653	2,7%
3- Tesouraria (III)	1.849	0,0%
4- Imóveis (IV)	196.344.485	14,6%
Total da Carteira	1.341.565.209	100,0%

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Bradesco, HSBC, Caixa, Santander, Itaú.

(I) Valor em Cotas do Fundo Caixa FI Brasil DI, HSBC DI LP, BB Institucional, Santander FIC Corporate, Bradesco Premium, Bradesco IRF-M1 e Itaú Institucional que está alocado em títulos privados de baixo risco de crédito.

(II) Valor em Cotas dos Fundos: HSBC DI LP, Bradesco Premium, BB Institucional e Santander FIC Corporate, investido em outros fundos de investimento.

(III) Recursos mantidos em Tesouraria nos fundos investidos.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/08/2012.

Rioprevidência - Setembro de 2012

Posição da Carteira em 28/09/2012, por Limites do PAI e Resolução nº 3.922/10

Segmento	Tipo de Ativo	Valores (R\$)	% (V)	Limites PAI (% total)	Limite da Res. nº 3.922/10
Renda Fixa	TPF	111.205.586	0,14%	100,0%	Até 100,0%
Renda Fixa (I)	FI/FIC RF ou Referenciado	223.164.994	0,29%	80,0%	Até 80,0%
Renda Fixa (II)	FI/FIC RF ou Referenciado	810.850.144	1,04%	4,0%	Até 30,0%
Renda Fixa	FI/FIC RF ou Referenciado (Crédito Privado)	0	0,00%	0,0%	Até 5,0%
Renda Fixa	Op. Compromissada com TPF	0	0,00%	2,8%	Até 15,0%
Total Renda Fixa		1.145.220.724	1,47%		
Total do Ativo (III) (Res. 3.922/10)		77.836.186.328			
Imóveis (IV)	Terrenos e Edificações	196.344.485			

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Bradesco, HSBC, Caixa, Santander, Itaú.

Glossário:

TPF - Título Público Federal

FI/FIC - Fundos de Investimento

PAI - Plano Anual de Investimentos (Limites definidos no PAI)

(I) Subíndices do IMA ou do IDKA, exceto subíndice atrelado a taxa de juros de 1 dia.

(II) Qualquer indicador de desempenho de Renda Fixa. Inclui valor em cotas dos Fundos : Caixa FI Brasil, HSBC DI LP, BB Institucional, Santander FIC Corporate, Bradesco Premium, Bradesco IRF-M1 e Itaú Institucional, que permite a alocação em títulos privados de baixo risco de crédito

(III) Valor total do Ativo em 31/08/2012.

(IV) Refere-se ao valor apurado em 31/08/2012.

(V) Refere-se ao valor do ativo total apurado em 31/08/2012.

Em setembro, as aplicações financeiras do RIOPREVIDÊNCIA se concentraram em cotas de Fundos de Investimento Referenciado DI, cujos lastros são predominantemente títulos públicos federais. Uma parcela menor foi aplicada em fundos atrelados ao IRF-M1, que apresentam baixa volatilidade.

A estratégia de alocação de recursos segue os critérios estabelecidos na legislação vigente, no Plano Anual de Investimentos e pelo Comitê de Investimentos.

Setembro de 2012

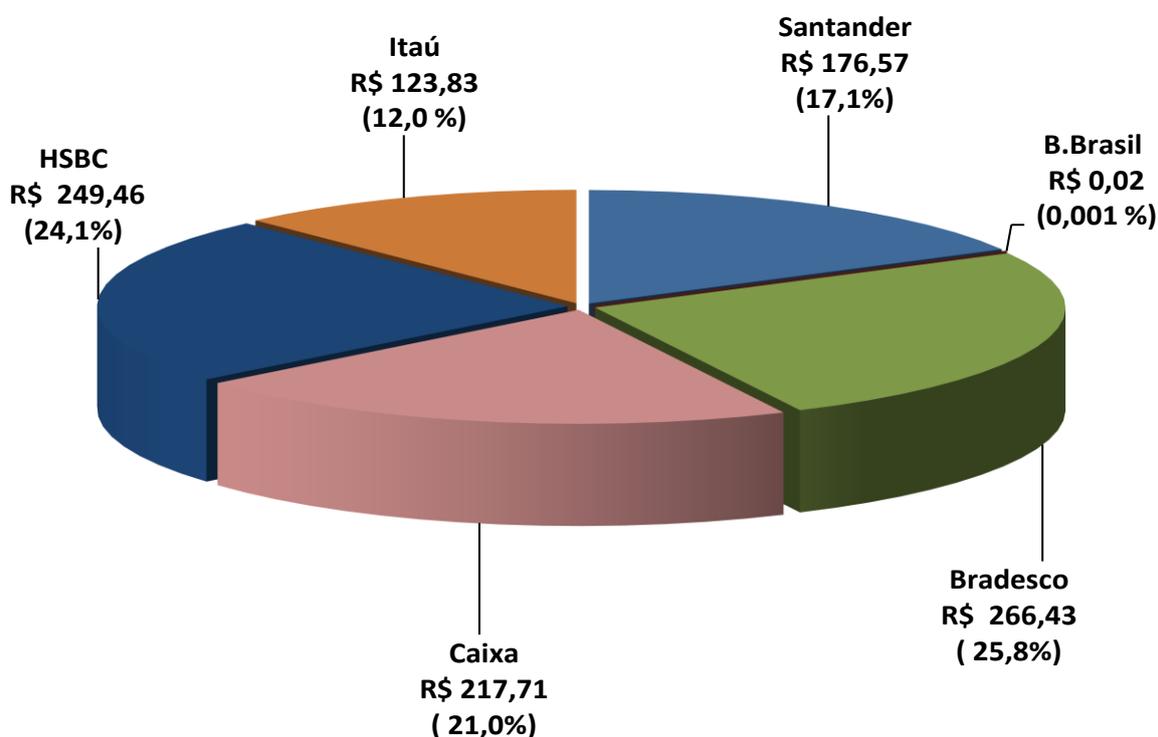
Fundos de Investimento			Participação do RIOPREVIDÊNCIA				Rent. Acum. (%) Tx. Adm.				
Nome do Fundo	Tipo de Fundo	Gestor	Quantidade Total de Cotas	Valor Unitário das Cotas	PL dos Fundos R\$ MM	Part. % no PL dos Fundos	Valor dos Fundos				
							Mês	Ano	12 M.	(%a.a.)	
FI Brasil REF DI LP	REF DI	CAIXA	203.333.128,12	1,87778	381,82	5,39%	20,59	0,53	6,77	9,67	0,20
FI Aliança-Renda Fixa	R Fixa	CAIXA	156.032.344,26	2,15760	336,66	13,65%	45,94	0,54	6,97	9,88	0,20
FI Brasil IRF-M1	R Fixa	CAIXA	2.053.603.087,38	1,28346	2.635,72	5,74%	151,18	0,52	7,47	10,23	0,20
BB Institucional FI Renda Fixa (*)	R Fixa	BBDTVM	341.893.767,40	4,57096	1.562,78	0,00%	0,02	0,56	6,72	9,68	0,20
Bradesco FI RF DI Federal Extra	REF DI	BRAM-Asset	588.476.862,91	6,14367	3.615,41	0,10%	3,55	0,52	6,57	9,39	0,15
Bradesco FI RF DI Premium	REF DI	BRAM-Asset	475.180.182,25	6,11651	2.906,44	6,57%	190,90	0,54	6,79	9,79	0,20
Bradesco FI RF IRF-M1	R Fixa	BRAM-Asset	539.529.408,41	1,27347	687,07	10,48%	71,98	0,53	7,49	10,27	0,20
Santander FIC FI Soberano	REF DI	Sant.-Asset	11.876.892,38	14,44860	171,60	2,31%	3,97	0,51	6,56	9,37	0,20
Santander FIC FI Corporate	REF DI	Sant.-Asset	313.916.398,36	6,29579	1.976,35	8,73%	172,60	0,54	6,76	9,73	0,20
Itaú Soberano Ref. DI LP FI	REF DI	B. Itaú	151.568.663,41	24,64097	3.734,80	0,29%	10,93	0,52	6,52	9,33	0,15
Itaú Institucional Ref. DI FI	REF DI	B. Itaú	360.102,08	1,596,86	575,03	19,63%	112,89	0,55	6,73	9,61	0,18
HSBC FI REF. DI LP	REF DI	HSBC	682.421.778,95	15,30180	10.442,28	2,39%	249,47	0,56	6,76	9,72	0,15
TOTAL							1.034,02				

Fonte: RIOPREVIDÊNCIA, B.Brasil, Bradesco, Caixa, HSBC, Santander, Itaú.

(*) - Valor bloqueado, em verificação pelo Rioprevidência.

No encerramento do mês de setembro, as aplicações financeiras em fundos de investimento totalizaram R\$ 1.034.015.137,93 distribuídos da forma abaixo:

Participação por Instituição Financeira em Fundos de Investimento - R\$ Milhões



Carteira Própria Certificados Financeiros do Tesouro - Posição em Setembro de 2012

Custodiante	Ativo	Código	Data de Emissão	Data de Compra	Data de Vencimento	Quantidade	Indexador	Cupom/Taxa (%aa)	PU Compra (R\$)	PU Atual (R\$)	Característica do Título	Valor Financeiro (R\$)
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A554	14/12/99	14/12/99	15/10/2012	23.181	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.842,17	Pós-Fixado	65.884.342,77
BANCO ITAÚ S.A.	CFT-A	HSTN_A555	14/12/99	14/12/99	15/11/2012	15.946	IGP-DI	6,00	1.000,00	2.842,17	Pós-Fixado	45.321.242,82
											39.127	111.205.585,59